

# Összetett indexek gazdaságpolitikai alkalmazása: a Globális Vállalkozói Index

Szerb László <sup>a, b</sup>, Rappai Gábor <sup>a</sup>, Kehl Dániel <sup>a</sup>  
<sup>a</sup> Pécsi Tudományegyetem, Közgazdaságtudományi Kar  
<sup>b</sup> szerb@ktk.pte.hu

Hosszú ideje igény van arra, hogy a komplex, többdimenziós jelenségeket egy mutatóval is le lehessen írni. Az idők során az egyszerűbb indikátorok mellett az összetett indikátorok is egyre inkább teret nyertek<sup>1</sup>. A legbonyolultabb kompozit indexek jellemzően nagyszámú egyéni indikátorból és több szinten épülnek fel, számos kihívás elé állítva az indexek készítőit és felhasználóit, értelmezőit egyaránt. Az OECD kézikönyve jó útmutatót ad az ilyen indexek technikai elkészítéséhez, ugyanakkor rámutat arra is, hogy mennyi változata és buktatója is van a technika alkalmazásának<sup>2</sup>. Az elmúlt időszakban különösen a komponensek súlyozása és az aggregálás került a figyelem középpontjába, mint amelyek a leginkább befolyásolhatják a végső eredményt.<sup>3</sup> A súlyozásnak fontos gazdaságpolitikai következménye is van, hogy mennyiben is helyettesíthetők is egymással a komponensek. A részleges kompenzációs technikák egyik korai változata Rappai és Szerb (2011) tanulmánya.<sup>4</sup> A szűk keresztmetszetekért történő büntetés alapötlete, hogy a magasabb értékű komponensek teljesítményét a szűk keresztmetszetek csökkentik, azaz az egyes komponensek között csupán korlátozott helyettesíthetőség áll fenn. A későbbiekben a módszer kibővült a komponensek átlagra igazításának technikájával<sup>5</sup>. A jelen tanulmány célja, hogy a Globális Vállalkozói Index (GEI) példáján keresztül bemutassa, hogy hogyan készíthető egy olyan kompozit index, amely az eddigieknél alkalmasabb gazdaságpolitikai javaslatok megalapozására. A GEI 14 pillére normált értékeinek átlaga jelentős eltérést mutat, így jelentős különbségek vannak az egyes pillérek átlagának javításához szükséges erőforrások terén is. Mivel a GEI-t szeretnénk gazdaságpolitikai célok erőforrás-optimalizálására alkalmazni, az egyes pillérértékek ugyanolyan mértékű marginális javulásához szükséges pótlólagos erőforrásoknak mind a 14 pillér estében azonosnak kellene lenniük. Az összes országra és mind a 14 pillérre gyakorolt összes marginális hatás kiszámítása nehézkes feladat lenne, ezért egy egyszerűbb megoldást javasolunk: a komponensek marginális hatásainak kiegyensúlyozását az összes ország átlagos pillérértékeire vonatkozóan. Ez a módszer csökkenti, de nem eliminálja teljesen a marginális hatások kiszámításakor keletkező torzulást. Módszerünk egyenlővé teszi a 14 pillér átlagát kiegyenlíti, vagy másképpen fogalmazva a marginális hatásokat az átlagon kiegyenlíti, de ezt úgy teszi, hogy közben a normálás során kialakított kritikus, [0;1] tartományban maradjunk. Egy lehetséges, több szempontból is alkalmas, módszer az eredeti értékek azonos, k-adik hatványra emelése, mellyel tulajdonképp valamennyi megfigyelést önmagával súlyozunk.

<sup>1</sup> Saltelli, A. (2007) Composite indicators between analysis and advocacy. *Social indicators research*, 81(1), 65-77.

<sup>2</sup> Handbook on constructing composite indicators, Joint Research Centre, European Union, OECD, p. 158

<sup>3</sup> Greco, S., Ishizaka, A., Tasiou, M., & Torrisi, G. (2018). On the methodological framework of composite indices: A review of the issues of weighting, aggregation, and robustness. *Social Indicators Research*, 1-34.

<sup>4</sup> Rappai G. - Szerb L. (2011) Összetett indexek készítése új módon: a szűk keresztmetszetekért történő büntetés módszere, Közgazdaságtudományi és Regionális Tudományok Intézete, Pécsi Tudományegyetem Közgazdaságtudományi Kar Műhelytanulmányok 2011/1

<sup>5</sup> Acs, Z. J.; E. Autio, L. Szerb (2014) National Systems of Entrepreneurship: Measurement issues and policy implications, *Research Policy* 43(3), 476-494